

Fecha de Publicación: 21 de octubre de 2015

Fecha de Información: 19 de octubre de lunes <sup>1</sup>

## INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$1363.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.3%.<sup>2</sup>

**Cuadro No. 1**  
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	224.7	249.9	132.9	88.0	5.1	24.7	112.0
15-35	478.1	328.2	204.2	135.0	76.5	295.6	47.5
36-60	0.9	36.5	20.0	0.0	16.5	0.9	0.0
61-90	3.3	6.4	0.0	0.0	6.4	3.3	0.0
91-180	116.2	45.1	23.7	0.0	21.4	116.2	0.0
>180	7.7	25.7	20.0	0.0	5.7	7.7	0.0
<b>Total</b>	<b>830.9</b>	<b>691.8</b>	<b>400.8</b>	<b>223.0</b>	<b>131.5</b>	<b>448.4</b>	<b>159.5</b>

\* Cifras en millones de dólares

\*\*Incluye operaciones interbancarias y operaciones con los otros agentes

\*\*\*Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior.

**Cuadro No. 2**

### Devaluación Implícita Ponderada por monto Anualizada

Rango	Sector Financiero*	Otros Agentes sin intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	3.6 %	4.3 %	3.5 %	3.8 %
15-35	4.5 %	4.6 %	4.3 %	4.4 %
36-60	-	4.9 %	4.1 %	4.9 %
61-90	-	4.9 %	4.4 %	4.7 %
91-180	-	5.1 %	4.6 %	4.7 %
>180	-	5.0 %	4.4 %	4.9 %
<b>Total</b>	<b>3.9 %</b>	<b>4.6 %</b>	<b>4.3 %</b>	<b>4.3 %</b>

\*Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

<sup>1</sup> Datos provisionales.

<sup>2</sup> El monto negociado diario corresponde a las operaciones de compra y venta evitando la doble contabilización de las operaciones interbancarias. Además, la fórmula para la devaluación implícita es:  $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (360/\text{Plazo}) - 1)$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

**Cuadro No. 3**  
**Vencimientos de Forwards**

Sectores	19 al 23 de octubre				26 al 30 de octubre				2 al 6 de noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	17	224	3730	3814	26	115	2877	3303	7	137	2533	2486
<b>Intragrupoy off-shore***</b>	0	0	2276	1304	0	0	1720	885	0	0	1538	825
<b>Otros</b>	224	17	660	1547	115	26	825	1235	137	7	364	1124
<b>Total</b>	<b>241</b>	<b>241</b>	<b>6666</b>	<b>6666</b>	<b>141</b>	<b>141</b>	<b>5423</b>	<b>5423</b>	<b>144</b>	<b>144</b>	<b>4435</b>	<b>4435</b>

\* Cifras en millones de dólares; No incluye operaciones aceptadas por Cámaras de Riesgo Central de Contraparte.

\*\*Incluye operaciones interbancarias y con otros agentes

\*\*\*Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior.